



Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 04. März 2020
Wirksamkeitsdatum: 04. Juni 2020
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	Taylor Wimpey Plc
ISIN	GB0008782301
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer 1.6.7 (2).
Optionskontrakt auf Aktien	
Futures-Kontrakt auf Aktien	TWFG
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Die Gesellschaft Taylor Wimpey Plc hat die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von GBP 0,1099 je Aktie bekannt gegeben.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft unter www.taylorwimpey.co.uk.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.



Prozedere

R-Faktor Methode

S1	Schlussauktionspreis der Aktie
S2	S1 minus Sonderdividende
R-Faktor	$S2 / S1$

Futures

1. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

- Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauffolgenden Börsentages werden die Settlement-Preise vom letzten Cum-Handelstag mit dem R-Faktor multipliziert.
- Die neue Kontraktgröße errechnet sich wie folgt:
Kontraktgröße neu = Kontraktgröße alt / R-Faktor
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

- Es wird ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt mit Standardkontraktgröße 1000.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Sobald die neuen Kontrakte zum Handel zur Verfügung stehen und keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten ausgesetzt und eingestellt.
- Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten TWFG keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für einen der ursprünglichen Kontrakte TWFG am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung dieses Kontraktes und keine Einführung eines neuen Kontrakts für diesen.